上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014年12月31日

基金管理人：长盛基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
送出日期：2015年3月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2014年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛上证市值百强ETF
基金主代码	510700
交易代码	510700
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年4月24日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,213,677.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年5月31日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金跟踪投资标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。
业绩比较基准	上证市值百强指数
风险收益特征	本基金为被动式投资的股票指数型基金，预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合风险收益特征相近，属于高风险、高收益的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年4月24日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	9,224,399.67	2,174,479.58
本期利润	16,700,571.04	-131,595.90
加权平均基金份额本期利润	0.4409	-0.0009
本期基金份额净值增长率	59.83%	-6.15%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.7020	-0.1107
期末基金资产净值	24,857,600.48	96,569,645.48
期末基金份额净值	2.698	1.688

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即12月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	51.91%	1.86%	54.81%	1.93%	-2.90%	-0.07%
过去六个月	70.11%	1.47%	71.43%	1.52%	-1.32%	-0.05%
过去一年	59.83%	1.29%	60.56%	1.33%	-0.73%	-0.04%
自基金合同生效起至今	50.01%	1.31%	49.21%	1.37%	0.80%	-0.06%

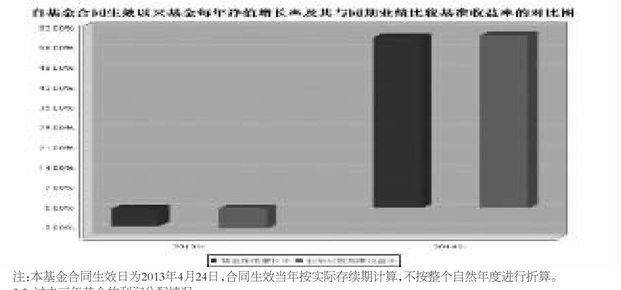
注：本基金业绩比较基准=上证市值百强指数

上证市值百强指数是由上海证券交易所授权、中证指数有限公司编制并发布的中国A股市场指数。该指数从市值管理的角度，综合反映上证全指中市值最大、成交最活跃的100只股票的整体表现。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照100%比例采取再平衡，并计算基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为2013年4月24日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2014年度及2013年4月24日（基金合同生效日）至2013年12月31日止会计期间未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于1999年3月26日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币18900万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至2014年12月31日，基金管理人共管理三十七只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外QFII基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵宏宇	本基金基金经理，长盛电子信息主题灵活配置混合型基金基金经理。	2013年4月24日	–	7年	男，1972年6月出生，中国国籍。四川大学工商管理学院管理学（金融投资研究方向）博士。历任美国晨星公司投资顾问部门数量分析师，招商银行博士后工作站博士后研究员。2007年8月加入长盛基金管理公司，历任金融工程研究员、产品开发经理，首席产品开发师，金融工程与量化投资部副总监、长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理等职务。现任上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金（本基金）基金经理，长盛电子信息主题灵活配置混合型基金基金经理。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司对该基金过去4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边90%置信水平对1 日、3 日、5 日的交易片段进行T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为上证市值百强指数，由上海证券市场规模大、流动性好、最具代表性的100只股票组成，综合反映上海证券市场最具市场影响力的市值龙头企业的整体状况。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

2014年度股票市场呈现前弱后强的走势，特别是在央行降息的刺激下，大盘股票的呈现低估值修复行情，市值较大的蓝筹股票表现较好，本基金净值增长也表现突出。本基金在基金合同允许的投资范围内，最大程度投资并跟踪分享蓝筹股票市值增长的红利。在报告期内操作中，基金管理人严格遵守基金合同，在成分股权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末（2014年12月31日），本基金份额净值为2.698元，本报告期份额净值增长率为59.83%，同期业绩比较基准增长率为60.56%。本报告期内日均跟踪偏离度绝对值均值为0.05%，年化跟踪误差为1.91%，控制在投资目标之内。本基金与标的指数产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用以及替代性策略产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为股票市场受益于经济短期回暖与政策利好预期，以及政策对各项经济改革的具体实施驱动，预期2015年度主题政策驱动的市场行情有望获得延续。特别是随着新的一年各项经济改革及政策的逐步推进，上证市值百强所代表的大盘蓝筹价值股票预期还会有一定上涨空间。

作为被动型指数基金，我们将继续秉承指数化投资策略，积极应对成分股权重变动、基金申购赎回等因素对指数跟踪带来的影响，控制基金的跟踪误差。以实现投资者获取指数投资收益的投资目标，充分发挥ETF的投资工具功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第二十二条中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2014年12月31日，期末可供分配利润为6,468,366.37元，未分配利润已实现部分为6,468,366.37元，未分配利润未实现部分为1,818,030.85元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自2014年9月5日至2014年11月20日、2014年11月24日至2014年12月31日期间出现连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师汪棣、沈兆杰于2015年3月23日对本基金2014年12月31日的资产负债表、2014年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2015)第20197号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产：		
银行存款	799,876.09	1,246,899.16
结算备付金	22,977.08	5,860.32
存出保证金	2,482.26	17,875.10
交易性金融资产	24,375,610.56	95,668,914.95
其中：股票投资	24,375,610.56	95,668,914.95
基金投资	–	–
债券投资	–	–
资产支持证券投资	–	–
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	–	–
应收利息	178.46	259.90
应收股利	–	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	25,201,124.45	96,939,809.43
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负债：		
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	–	21,369.93
应付赎回款	–	–
应付管理人报酬	13,899.01	43,718.09
应付托管费	2,779.81	8,743.62
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	6,845.15	15,626.71
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	320,000.00	280,705.60
负债合计	343,523.97	370,163.95
所有者权益：		
实收基金	16,571,203.26	102,901,314.00
未分配利润	8,286,397.22	-6,331,668.52
所有者权益合计	24,857,600.48	96,569,645.48
负债和所有者权益总计	25,201,124.45	96,939,809.43

注：1、报告截止日2014年12月31日，基金份额净值2.698元，基金份额总额9,213,677.00份。

2、本财务报表的比较期间为2013年4月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年4月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	17,691,973.30	1,973,490.55
1.利息收入	9,388.12	208,366.36
其中：存款利息收入	9,380.65	208,147.01
债券利息收入	7.47	219.35
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	–	–
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	10,119,463.90	3,927,633.94
其中：股票投资收益	8,387,111.62	-880,036.39
基金投资收益	–	–
债券投资收益	1,970.33	41,729.65
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	1,730,381.95	4,765,940.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,476,171.37	-2,306,075.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）	86,949.91	143,565.73
减：二、费用	991,402.26	2,105,086.45
1.管理人报酬	315,798.75	722,671.32
2.托管费	63,159.79	144,534.25
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	34,944.11	814,593.58
5.利息支出	–	–
其中：卖出回购金融资产支出	–	–
6.其他费用	577,499.61	423,287.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	16,700,571.04	-131,595.90
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	16,700,571.04	-131,595.90

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	102,901,314.00	-6,331,668.52	96,569,645.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	16,700,571.04	16,700,571.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-86,330,110.74	-2,082,505.30	-88,412,616.04
其中：1.基金申购款	201,436,925.02	-4,607,108.76	196,829,816.26
2.基金赎回款	-287,767,035.76	2,524,603.46	-285,242,432.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	16,571,203.26	8,286,397.22	24,857,600.48
项目	上年度可比期间 2013年4月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	622,680,523.00	–	622,680,523.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-131,595.90	-131,595.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-519,779,209.00	-6,200,072.62	-525,979,281.62
其中：1.基金申购款	321,939,371.26	-16,986,524.18	304,952,847.08
2.基金赎回款	-841,718,580.26	10,786,451.56	-830,932,128.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	102,901,314.00	-6,331,668.52	96,569,645.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵 林培富 龚珉

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第125号《关于核准上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准，由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币622,671,073.00元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第211号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2013年4月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为622,680,523.00份基金份额，其中认购资金利息折合9,450.00份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

为了与上证市值百强指数进行对比，根据《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，长盛基金管理有限公司确定2013年5月15日为本基金的基金份额折算日。当日上证市值百强指数收盘值为1,791.807点，本基金资产净值为620,348,678.96元，折算前基金份额总额为622,680,523.00份，折算前基金份额净值为0.996元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为0.55600584，折算后基金份额总额为346,213,677.00份，折算后基金份额净值为1.792元。长盛基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司于2013年5月16日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证基字[2013]第128号文审核同意，本基金346,213,677.00份基金份额于2013年5月31日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的主要投资范围为标的指数上证市值百强指数的成份股和备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的90%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、一级市场股票(包括首次公开发行或增发)、债券资产、回购、银行存款、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：上证市值百强指数。

本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司以本基金为目标ETF，于2013年5月10日募集成立了长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“长盛上证市值百强ETF联接基金”)。长盛上证市值百强ETF联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。2014年7月3日，根据中国证监会基金部函[2014]663号《关于长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》，长盛上证市值百强ETF联接基金正式变更为长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于2015年3月23日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(“长盛基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“长盛上证市值百强ETF联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据本基金的基金管理人于2014年7月4日公布的《长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议生效公告》，《长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》已于2014年7月3日修改为《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》并生效。根据修订后的基金合同，长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金不再将本基金作为投资标的。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金未开立关联方交易单元。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年4月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	315,798.75	722,671.32
其中：支付销售机构的客户维护费	–	–

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年4月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	63,159.79	144,534.25

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.1% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金基金管理人于本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014年12月31日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
长盛上证市值百强ETF联接基金	–	–	22,000,000.00	38.4500%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年4月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	799,876.09	9,032.09	1,246,899.16	194,388.76

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600332	白云山	2014年12月4日	重大事项停牌	27.11	2015年1月13日	29.82	5,700	153,187.08	154,527.00	–
601299	中国北车	2014年10月27日	重大事项停牌	7.10	2014年12月31日	7.81	52,800	248,542.91	374,880.00	–
601766	中国南车	2014年10月27日	重大事项停牌	6.38	2014年12月31日	7.02	62,400	283,511.93	398,112.00	–

注：1、本基金截至2014年12月31日持有的中国北车、中国南车已于本期末复牌，但交易仍不活跃、流通仍受限，因此仍作为流通受限股票。

2、本基金截至2014年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 23,448,091.56元，属于第二层次的余额为 927,519.00元，无属于第三层次的余额(2013年12月31日：第一层次94,670,550.95元，第二层次998,364.00元，无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)基金申购款

2014年度，本基金申购基金份额的对价总额为196,829,816.26元(2013年度：304,952,847.08)，其中包括以股票支付的申购款190,716,231.36元和以现金支付的申购款6,113,584.90元(2013年度：以股票支付的申购款296,624,197.62元和以现金支付的申购款8,328,649.46元)。

(3)除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	24,375,610.56	96.72
	其中：股票	24,375,610.56	96.72
2	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	822,853.17	3.27
7	其他各项资产	2,660.72	0.01
8	合计	25,201,124.45	100.00

注：上表所列股票投资项含可退替代估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	114,336.00	0.46
B	采矿业	1,234,958.00	4.97
C	制造业	4,997,741.66	20.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	661,457.70	2.66
E	建筑业	1,477,924.00	5.95
F	批发和零售业	330,131.00	1.33
G	交通运输、仓储和邮政业	421,768.00	1.70
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	786,033.00	3.16
J	金融业	13,480,833.60	54.23
K	房地产业	685,080.00	2.76
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	112,104.00	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	73,243.60	0.29
S	综合	–	–
	合计	24,375,610.56	98.06

8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	23,400	1,748,214.00	7.03
2	600016	民生银行	123,420	1,342,809.60	5.40
3	600036	招商银行	77,200	1,280,748.00	5.15
4	600030	中信证券	36,200	1,227,180.00	4.94
5	600837	海通证券	37,300	897,438.00	3.61
6	601166	兴业银行	51,500	849,750.00	3.42
7	600000	浦发银行	51,100	801,759.00	3.23
8	601668	中国建筑	68,000	495,040.00	1.99
9	601601	中国太保	15,300	494,190.00	1.99
10	601328	交通银行	71,500	486,200.00	1.96

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于http://www.csfunds.com.cn网站的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	918,285.00	0.95
2	600519	贵州茅台	591,019.90	0.61
3	600352	浙江龙盛	471,386.00	0.49
4	603000	人民网	458,246.00	0.47
5	600340	华夏幸福	385,227.16	0.40
6	600372	中航电子	358,582.20	0.37
7	601688	华泰证券	357,192.00	0.37
8	601818	光大银行	342,727.00	0.35
9	600887	伊利股份	321,822.20	0.33
10	601901	方正证券	280,630.00	0.29
11	600648	外高桥	271,827.00	0.28
12	600030	中信证券	268,236.21	0.28
13	601390	中国中铁	265,607.00	0.28
14	601939	建设银行	254,646.00	0.26
15	600498	烽火通信	245,451.00	0.25
16	601318	中国平安	239,037.00	0.25
17	600880	博瑞传播	235,034.20	0.24
18	600570	恒生电子	192,158.00	0.20
19	600011	华能国际	191,797.88	0.20
20	600688	上海石化	190,018.00	0.20

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601939	建设银行	802,892.50	0.83
2	601288	农业银行	595,803.00	0.62
3	600011	华能国际	542,856.50	0.56
4	601009	南京银行	483,868.69	0.50
5	600019	宝钢股份	473,190.00	0.49
6	601318	中国平安	451,796.92	0.47
7	600089	特变电工	401,915.50	0.42
8	600519	贵州茅台	353,431.21	0.37
9	600085	同仁堂	253,701.25	0.26
10	601800	中国交建	250,614.00	0.26
11	600252	中恒集团	250,470.09	0.26
12	600875	东方电气	234,012.08	0.24
13	600016	民生银行	228,758.43	0.24
14	600348	阳泉煤业	206,504.09	0.21
15	600036	招商银行	191,948.00	0.20
16	600498	烽火通信	185,997.00	0.19
17	601992	金隅股份	175,363.00	0.18
18	600259	广晟有色	175,281.22	0.18
19	600000	浦发银行	170,896.00	0.18
20	601958	金钼股份	170,250.03	0.18

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	11,187,810.73
卖出股票收入（成交）总额	11,430,213.47

注：本项中8.4.1、8.4.2、8.4.3表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

1、本基金跟踪复制标的指数上证市值百强指数，配置了上证市值百强指数成分股海通证券。

中国证监会2014年5月29日发布的《中国证监会对新股发行承销违规机构和个人采取监管措施》显示，海通证券因向禁止配售的配售对象配售股票、向投资者提供超出招股书范围的发行人信息等事项受到中国证监会“出具警示函”、“监管谈话”的监管措施。本基金认为：该监管措施对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

2、本基金跟踪复制标的指数上证市值百强指数，配置了上证市值百强指数成分股中国平安。

根据2014年12月8日中国证券监督管理委员会发布对中国平安控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》，决定对平安证券给予警告，没收保荐业务收入400万元，没收承销股票违法所得2867万元，并处以440万元罚款。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

除上述事项外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,482.26
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	178.46
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	2,660.72

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
480	19,195.16	768,632.00	8.34%	8,445,045.00	91.66%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	齐鲁证券有限公司客户信用交易担保证券账户	315,525.00	3.42%
2	许永煊	263,187.00	2.86%
3	郭金艳	200,000.00	2.17%
4	叶永红	180,746.00	1.96%
5	翟培欣	165,134.00	1.79%
6	王美华	162,020.00	1.76%
7	王均海	161,346.00	1.75%
8	光大证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	152,230.00	1.65%
9	陆建平	150,368.00	1.63%
10	温希英	149,010.00	1.62%

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	–	–

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年4月24日）基金份额总额	622,680,523.00
本报告期期初基金份额总额	57,213,677.00
本报告期基金总申购份额	112,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	160,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	–
本报告期期末基金份额总额	9,213,677.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本基金管理人于2014年4月16日发布公告，经公司第五届董事会第五十七次会议以及第六届董事会第一次会议审议通过，并报中国证监会审核批准，由高新先生担任公司董事长，凤良志先生因年龄原因不再担任公司董事长职务。根据公司章程相关规定，“董事长为公司的法定代表人”。公司已于2014年4月14日完成相关工商登记变更手续。

11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告，自2014年2月13日起，陈四清先生担任本行行长。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬46,000.00元，已连续提供审计服务2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	22,618,024.20	100.00%	20,591.42	100.00%	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
银河证券	1	–	–	–	–	–

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	32,977.80	100.00%	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

（1）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

（2）资力雄厚，信誉良好。

（3）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

（4）经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

（5）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

（6）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

（1）研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

（2）研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

（3）研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

（4）试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

（5）本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

（6）交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

（1）本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

（2）本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

长盛基金管理有限公司

2015年3月28日